

**上投摩根强化回报债券型证券投资基金**  
**2021 年第 3 季度报告**  
**2021 年 9 月 30 日**

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                              |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 上投摩根强化回报债券                                                                                                                                   |
| 基金主代码      | 372010                                                                                                                                       |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                       |
| 基金合同生效日    | 2011 年 8 月 10 日                                                                                                                              |
| 报告期末基金份额总额 | 375,316,361.48 份                                                                                                                             |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，通过主动管理，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率，实现基金资产的长期稳定增值。                                                                            |
| 投资策略       | 1、资产配置策略<br>本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，对股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%。本基金将遵循自上而下的配置原则，以宏观经济分析和政策分析为基础，根据对宏观经济运行趋势、国家财政政策与货币政策、市场流动性水平、债券市场和 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                 |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | <p>股票市场估值水平等因素的综合分析，对各大类资产的预期风险和收益进行动态评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，对大类资产配置比例进行动态优化管理。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金将采用积极主动的债券投资策略，以中长期利率分析为核心，结合宏观经济周期、宏观政策方向、收益率曲线形态、债券市场供求关系等分析，实施积极的债券投资组合管理。在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。</p> <p>3、其他投资策略：包括股票投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略。</p> |                 |
| 业绩比较基准          | 中证综合债券指数                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                 |
| 风险收益特征          | <p>本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。</p> <p>根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。</p>                                                                  |                 |
| 基金管理人           | 上投摩根基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                 |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 上投摩根强化回报债券 A                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 上投摩根强化回报债券 B    |
| 下属分级基金的交易代码     | 372010                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 372110          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 336,521,508.68 份                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 38,794,852.80 份 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) |                 |
|----------------|-----------------------------------------|-----------------|
|                | 上投摩根强化回报债券<br>A                         | 上投摩根强化回报债券<br>B |
|                | 1.本期已实现收益                               | 4,827,301.57    |
| 2.本期利润         | 7,196,030.27                            | 740,847.57      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0206                                  | 0.0197          |
| 4.期末基金资产净值     | 515,232,223.25                          | 57,190,949.17   |
| 5.期末基金份额净值     | 1.5311                                  | 1.4742          |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

## 1、上投摩根强化回报债券 A:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 1.48%      | 0.16%         | 1.70%          | 0.06%                 | -0.22% | 0.10% |
| 过去六个月          | 1.94%      | 0.12%         | 2.95%          | 0.05%                 | -1.01% | 0.07% |
| 过去一年           | 4.71%      | 0.11%         | 5.19%          | 0.05%                 | -0.48% | 0.06% |
| 过去三年           | 20.84%     | 0.18%         | 14.89%         | 0.06%                 | 5.95%  | 0.12% |
| 过去五年           | 18.69%     | 0.18%         | 19.74%         | 0.07%                 | -1.05% | 0.11% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 60.70%     | 0.27%         | 56.43%         | 0.08%                 | 4.27%  | 0.19% |

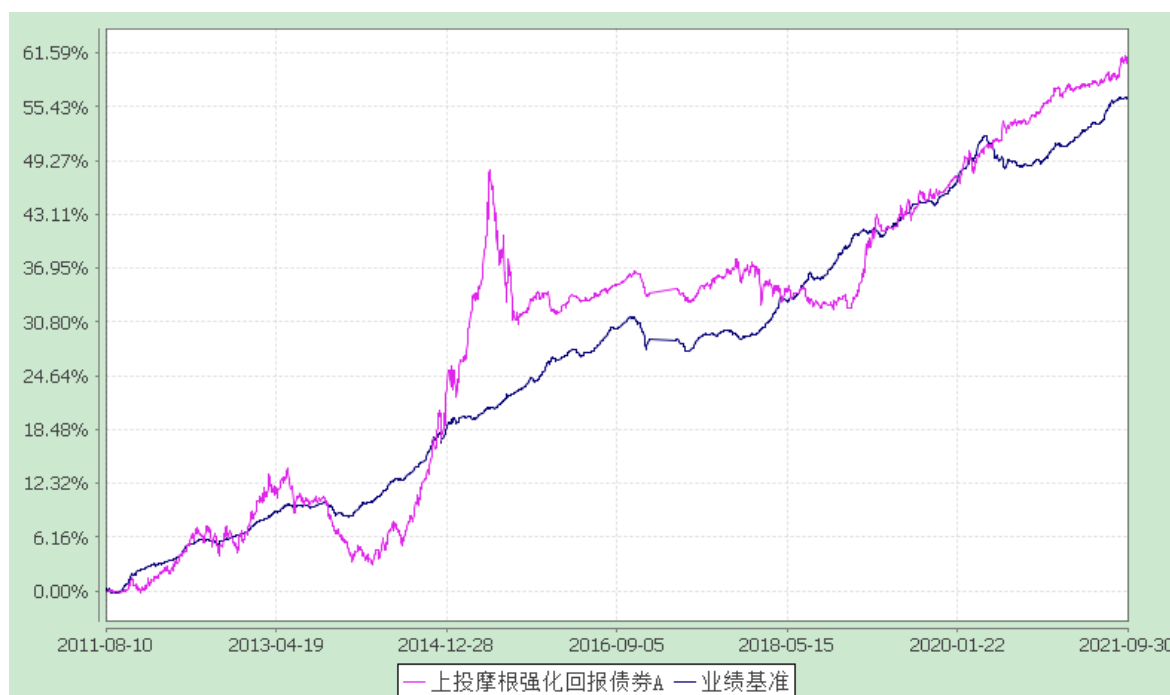
## 2、上投摩根强化回报债券 B:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 1.38%      | 0.16%         | 1.70%          | 0.06%                 | -0.32% | 0.10% |
| 过去六个月          | 1.73%      | 0.12%         | 2.95%          | 0.05%                 | -1.22% | 0.07% |
| 过去一年           | 4.29%      | 0.11%         | 5.19%          | 0.05%                 | -0.90% | 0.06% |
| 过去三年           | 19.37%     | 0.18%         | 14.89%         | 0.06%                 | 4.48%  | 0.12% |
| 过去五年           | 16.35%     | 0.18%         | 19.74%         | 0.07%                 | -3.39% | 0.11% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 54.32%     | 0.28%         | 56.43%         | 0.08%                 | -2.11% | 0.20% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根强化回报债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2011 年 8 月 10 日至 2021 年 9 月 30 日)

#### 1. 上投摩根强化回报债券 A:



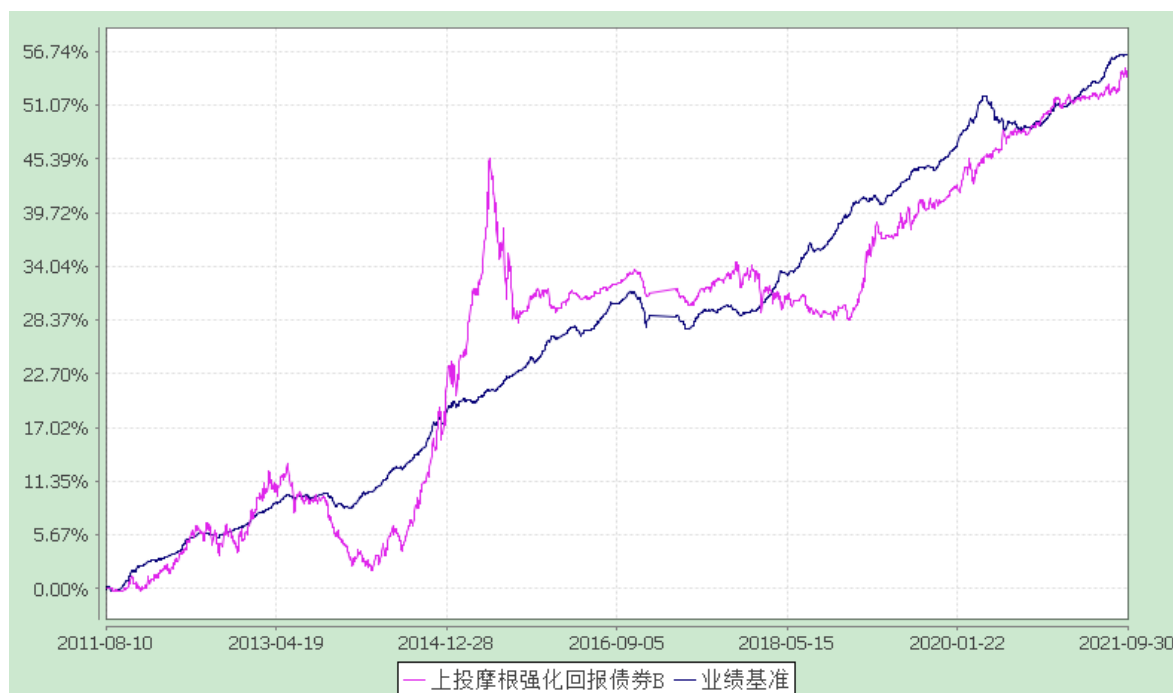
注：本基金本类份额生效日为 2011 年 8 月 10 日，图示的时间段为本类份额生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自 2015 年 10 月 10 日起，将基金业绩比较基准由“中信标普全债指数”变更为“中证综

合债券指数收益率”。

## 2. 上投摩根强化回报债券 B:



注：本基金本类份额生效日为 2011 年 8 月 10 日，图示的时间段为本类份额生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自 2015 年 10 月 10 日起，将基金业绩比较基准由“中信标普全债指数”变更为“中证综合债券指数收益率”。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                              |
|----|---------|-------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                 |
| 唐瑭 | 本基金基金经理 | 2021-04-16  | -    | 13 年   | 唐瑭女士，英国爱丁堡大学硕士，2008 年 2 月至 2010 年 4 月任 JPMorgan(EMEA)分析师。2011 年 3 月加入上投摩根基金管理有限 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>公司,先后担任研究员、基金经理助理、基金经理,2015年5月至2018年11月担任上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理,2015年12月至2020年5月担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理,2015年12月至2018年9月同时担任上投摩根轮动添利债券型证券投资基金基金经理,自2016年5月至2021年3月担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理,自2016年6月至2021年3月担任上投摩根分红添利债券型证券投资基金基金经理,2016年6月至2021年3月担任上投摩根纯债添利债券型证券投资基金基金经理,2016年8月至2018年9月同时担任上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2017年1月至2021年3月同时担任上投摩根安丰回报混合型证券投资基金基金经理,2017年1月至2018年10月同时担任上投摩根安泽回报混合型证券投资基金基金经理,2018年2月至2020年5月同时担任上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理,2018年2月至7月同时担任上投摩根安腾回报混合型证券投资基金基金经理,2019年4月至2020年9月同时担任上投摩根优信增利债券型证券投资基金基金经理,自2019年4月至2021年3月同时担任上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金基金经理,2019年8月至2020年11月同时担任上投摩根瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理,自2021年4月起同时担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金和上投摩根安享回报一年持有期债券型证</p> |
|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |                   |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|-------------------|------------|---|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                   |            |   |      | 券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月起同时担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 陈圆明 | 本基金基金经理、绝对收益投资部总监 | 2019-11-15 | - | 12 年 | 陈圆明先生，自 2009 年 7 月至 2010 年 6 月在东海证券有限责任公司任研究员；2010 年 7 月至 2011 年 8 月在国联安基金管理有限公司任研究员；2011 年 8 月至 2014 年 9 月为国投瑞银基金管理有限公司任研究员、投资经理；2014 年 9 月至 2019 年 2 月在鹏华基金管理有限公司任投资经理、绝对收益副总监；2019 年 2 月起加入上投摩根基金管理有限公司，现担任绝对收益投资部总监兼基金经理；自 2019 年 4 月起担任上投摩根安裕回报混合型证券投资基金和上投摩根安隆回报混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月起同时担任上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月起同时担任上投摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月起同时担任上投摩根安荣回报混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月起同时担任上投摩根双债增利债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外，基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。



### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：无。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济增速有所放缓，消费数据持续疲弱，出口数据强劲但可持续性随着海外生产的恢复受到挑战，9 月份能源短缺和限产限电的情形加剧了市场对于后续经济增长的担忧。政策超预期降准，并加快地方政府债发行节奏，体现了对于经济的呵护，更多高层会议表露出对于宽信用的信息释放。通胀方面，大宗商品继续涨价，大量品种已经在历史高价位区间，其中供给受限（环保、碳排放和限电带来的影响）的周期品价格继续维持高位。全球能源价格持续上涨进一步推高通胀预期。债券市场在降准之后走出经济下行-货币宽松-债市走强的逻辑，随后在宽货币和宽信用之间博弈盘整。股票市场震荡上行，其中周期和能源板块表现出超赢。本基金在三季度提高了权益资产的配置，股票选择上增加了新能源中游制造业、煤化工新材料、供给侧受限的周

期行业龙头、钢铁、电力等。逐步降低了债券组合的久期。

展望四季度，能源短缺以及限产限电的影响目前来看三季度末将是拐点，政策已经相应纠正之前可能过紧的预期以保证生产端的需求。政府债加速供给，财政加速支出，结构性信贷将货币带向宽信用，社融增速逐月放缓的趋势将结束。全球能源价格持续上涨进一步推高通胀预期，中下游企业的成本压力增大，进而会对中下游需求产生损害。在这样的情况下，我们对债券持偏谨慎的态度。权益方面，精选未来增长确定性高的品种，规避因“涨价”而受损的品种。在中美关系紧张的背景下，我国产业升级的需求迫切，长期关注高端制造业投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根强化回报债券 A 份额净值增长率为:1.48%，同期业绩比较基准收益率为:1.70%，

上投摩根强化回报债券 B 份额净值增长率为:1.38%，同期业绩比较基准收益率为:1.70%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目       | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|----------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资     | 70,731,992.78  | 11.76        |
|    | 其中：股票    | 70,731,992.78  | 11.76        |
| 2  | 固定收益投资   | 518,503,324.60 | 86.18        |
|    | 其中：债券    | 518,503,324.60 | 86.18        |
|    | 资产支持证券   | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资    | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资  | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产 | -              | -            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 6,058,229.59   | 1.01   |
| 7 | 其他各项资产            | 6,378,753.20   | 1.06   |
| 8 | 合计                | 601,672,300.17 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 3,695,934.60  | 0.65         |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 35,267,855.02 | 6.16         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,116,496.55 | 3.16         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 5,714,411.04  | 1.00         |
| K  | 房地产业             | 661,770.72    | 0.12         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 7,275,524.85  | 1.27         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 70,731,992.78 | 12.36        |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 003816 | 中国广核  | 5,375,815 | 18,116,496.55 | 3.16         |
| 2  | 603588 | 高能环境  | 432,295   | 7,275,524.85  | 1.27         |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 118,164   | 5,714,411.04  | 1.00         |
| 4  | 000725 | 京东方 A | 998,318   | 5,041,505.90  | 0.88         |
| 5  | 002353 | 杰瑞股份  | 100,332   | 4,858,075.44  | 0.85         |
| 6  | 000661 | 长春高新  | 16,724    | 4,593,413.84  | 0.80         |
| 7  | 002982 | 湘佳股份  | 94,260    | 3,695,934.60  | 0.65         |
| 8  | 600507 | 方大特钢  | 457,500   | 3,609,675.00  | 0.63         |
| 9  | 300772 | 运达股份  | 68,304    | 3,572,299.20  | 0.62         |
| 10 | 000636 | 风华高科  | 116,099   | 3,238,001.11  | 0.57         |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 90,313,500.00  | 15.78        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,216,000.00  | 5.28         |
|    | 其中：政策性金融债 | 30,216,000.00  | 5.28         |
| 4  | 企业债券      | 73,227,747.50  | 12.79        |
| 5  | 企业短期融资券   | 149,996,000.00 | 26.20        |
| 6  | 中期票据      | 44,353,400.00  | 7.75         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 83,717,977.10  | 14.63        |
| 8  | 同业存单      | 46,678,700.00  | 8.15         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 518,503,324.60 | 90.58        |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 132009 | 17 中油 EB | 303,990 | 32,022,306.60 | 5.59         |

|   |         |               |         |               |      |
|---|---------|---------------|---------|---------------|------|
| 2 | 1280106 | 12 国网债 01     | 300,000 | 30,492,000.00 | 5.33 |
| 3 | 200014  | 20 付息国债<br>14 | 290,000 | 29,226,200.00 | 5.11 |
| 4 | 132015  | 18 中油 EB      | 250,650 | 26,270,626.50 | 4.59 |
| 5 | 113044  | 大秦转债          | 240,950 | 25,425,044.00 | 4.44 |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 34,094.76    |
| 2  | 应收证券清算款 | 478,771.93   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,832,270.86 |
| 5  | 应收申购款   | 33,615.65    |
| 6  | 其他应收款   | -            |

|   |      |              |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | -            |
| 8 | 其他   | -            |
| 9 | 合计   | 6,378,753.20 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1  | 132009 | 17 中油 EB | 32,022,306.60 | 5.59         |
| 2  | 132015 | 18 中油 EB | 26,270,626.50 | 4.59         |
| 3  | 113044 | 大秦转债     | 25,425,044.00 | 4.44         |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 上投摩根强化回报债券<br>A | 上投摩根强化回报债券<br>B |
|----------------|-----------------|-----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 427,249,187.70  | 37,958,522.55   |
| 报告期期间基金总申购份额   | 79,075,715.30   | 5,290,436.11    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 169,803,394.32  | 4,454,105.86    |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -               | -               |
| 本报告期期末基金份额总额   | 336,521,508.68  | 38,794,852.80   |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                                                | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |               |      |               | 报告期末持有基金情况    |        |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|---------------|------|---------------|---------------|--------|
|                                                                                                      | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构                                                                                                   | 1              | 20210701-20210930      | 94,373,577.20 | 0.00 | 13,500,000.00 | 80,873,577.20 | 21.55% |
| 产品特有风险                                                                                               |                |                        |               |      |               |               |        |
| 本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。 |                |                        |               |      |               |               |        |

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根强化回报债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根强化回报债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《上投摩根开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司

二〇二一年十月二十七日